新华鑫日享中短债债券型证券投资基金

2023 年第 3 季度报告

2023 年 9 月 30 日

基金管理人：新华基金管理股份有限公司

基金托管人：中国民生银行股份有限公司

报告送出日期：二〇二三年十月二十五日

§1 重要提示

基金管理人的董事会及董事保证本报告所载资料不存在虚假记载、误导性陈述或重大遗漏，并对其内容的真实性、准确性和完整性承担个别及连带责任。

基金托管人中国民生银行股份有限公司根据本基金合同规定，于 2023 年 10 月 24 日复核了本报告中的财务指标、净值表现和投资组合报告等内容，保证复核内容不存在虚假记载、误导性陈述或者重大遗漏。

基金管理人承诺以诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，但不保证基金一定盈利。

基金的过往业绩并不代表其未来表现。投资有风险，投资者在作出投资决策前应仔细阅读本基金的招募说明书。

本报告中财务资料未经审计。

本报告期自 2023 年 7 月 1 日起至 9 月 30 日止。

§2 基金产品概况

2.1 基金基本情况

基金简称	新华鑫日享中短债债券
基金主代码	004981
基金运作方式	契约型开放式
基金合同生效日	2018 年 12 月 19 日
报告期末基金份额总额	963,013,126.01 份
投资目标	本基金在严格控制投资风险和增强基金资产流动性的基础上，重点投资中短债主题证券，力争获取超过业绩比较基准的当期收入和投资总回报。
投资策略	本基金投资策略包括资产配置策略、债券投资策略、中小企业私募债券选择策略及资产支持证券的投资策略。 本基金将在基金合同约定的投资范围内，通过对宏观经济运行状况、

	国家货币政策和财政政策、国家产业政策及资本市场资金环境的研究，积极把握宏观经济发展趋势、利率走势、债券市场相对收益率、券种的流动性以及信用水平，优化固定收益类金融工具的资产比例配置。在有效控制风险的基础上，适时调整组合久期，以获得基金资产的稳定增值，提高基金总体收益率。		
业绩比较基准	中债总财富（1-3 年）指数收益率		
风险收益特征	本基金为债券型证券投资基金，属于证券投资基金中预期较低风险、较低收益的品种，其预期收益和风险水平低于股票型基金、混合型基金，高于货币市场基金。		
基金管理人	新华基金管理股份有限公司		
基金托管人	中国民生银行股份有限公司		
下属分级基金的基金简称	新华鑫日享中短债债券 A	新华鑫日享中短债债券 C	新华鑫日享中短债债券 B
下属分级基金的交易代码	004981	006695	007912
报告期末下属分级基金的份额总额	657,644,693.31 份	102,924,727.71 份	202,443,704.99 份

注：1、本基金于2019年10月11日起新增B类基金份额，B类基金份额代码为：007912；

2、本基金新增B类基金份额后，将分设A类、B类、C类三类基金份额，A类基金份额代码为：004981；C类基金份额代码为：006695。

§3 主要财务指标和基金净值表现

3.1主要财务指标

单位：人民币元

主要财务指标	报告期 (2023 年 7 月 1 日-2023 年 9 月 30 日)		
	新华鑫日享中短债债券 A	新华鑫日享中短债债券 C	新华鑫日享中短债债券 B

1.本期已实现收益	6,541,626.58	803,969.80	1,520,285.07
2.本期利润	5,322,415.99	614,500.42	1,189,407.33
3.加权平均基金份额本期利润	0.0062	0.0052	0.0058
4.期末基金资产净值	689,530,755.31	107,357,247.08	209,891,828.73
5.期末基金份额净值	1.0485	1.0431	1.0368

注：1、本期已实现收益指基金本期利息收入、投资收益、其他收入（不含公允价值变动收益）扣除相关费用后的余额，本期利润为本期已实现收益加上本期公允价值变动收益；

2、以上所述基金业绩指标不包括持有人认购或交易基金的各项费用（例如基金申购费赎回费等），记入费用后实际收益水平要低于所列数字。

3.2基金净值表现

3.2.1本报告期基金份额净值增长率及其与同期业绩比较基准收益率的比较

1、新华鑫日享中短债债券 A：

阶段	净值增长率①	净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①－③	②－④
过去三个月	0.57%	0.02%	0.41%	0.03%	0.16%	-0.01%
过去六个月	1.39%	0.02%	1.55%	0.03%	-0.16%	-0.01%
过去一年	2.44%	0.02%	2.34%	0.04%	0.10%	-0.02%
过去三年	9.41%	0.02%	9.92%	0.04%	-0.51%	-0.02%
自基金合同生效起至今	16.39%	0.02%	16.20%	0.04%	0.19%	-0.02%

2、新华鑫日享中短债债券 C：

阶段	净值增长率①	净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①－③	②－④
过去三个月	0.49%	0.02%	0.41%	0.03%	0.08%	-0.01%
过去六个月	1.24%	0.02%	1.55%	0.03%	-0.31%	-0.01%
过去一年	2.14%	0.02%	2.34%	0.04%	-0.20%	-0.02%
过去三年	8.46%	0.02%	9.92%	0.04%	-1.46%	-0.02%

自基金合同生效起至今	14.78%	0.02%	16.20%	0.04%	-1.42%	-0.02%

3、新华鑫日享中短债债券 B：

阶段	净值增长率①	净值增长率标准差②	业绩比较基准收益率③	业绩比较基准收益率标准差④	①－③	②－④
过去三个月	0.55%	0.02%	0.41%	0.03%	0.14%	-0.01%
过去六个月	1.37%	0.02%	1.55%	0.03%	-0.18%	-0.01%
过去一年	2.27%	0.02%	2.34%	0.04%	-0.07%	-0.02%
过去三年	8.08%	0.02%	9.92%	0.04%	-1.84%	-0.02%
自基金合同生效起至今	10.61%	0.02%	12.65%	0.05%	-2.04%	-0.03%

注：1、本基金于2019年10月11日起新增B类基金份额。

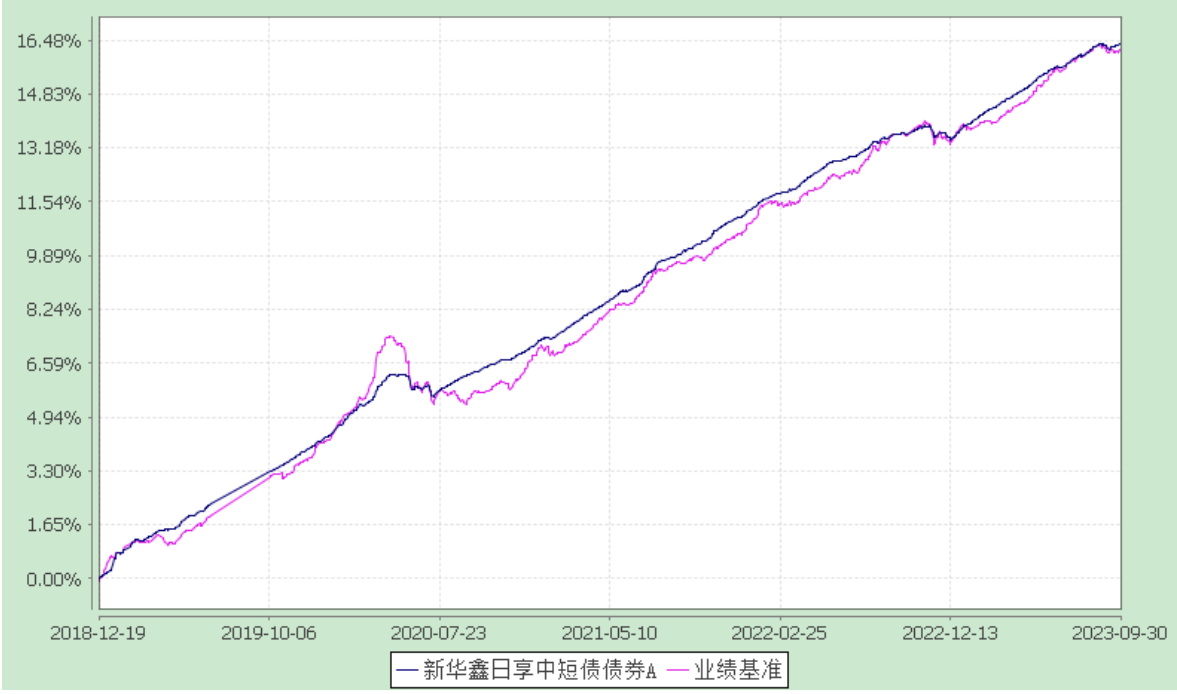
3.2.2 自基金合同生效以来基金累计净值增长率变动及其与同期业绩比较基准收益率变动的比较

新华鑫日享中短债债券型证券投资基金

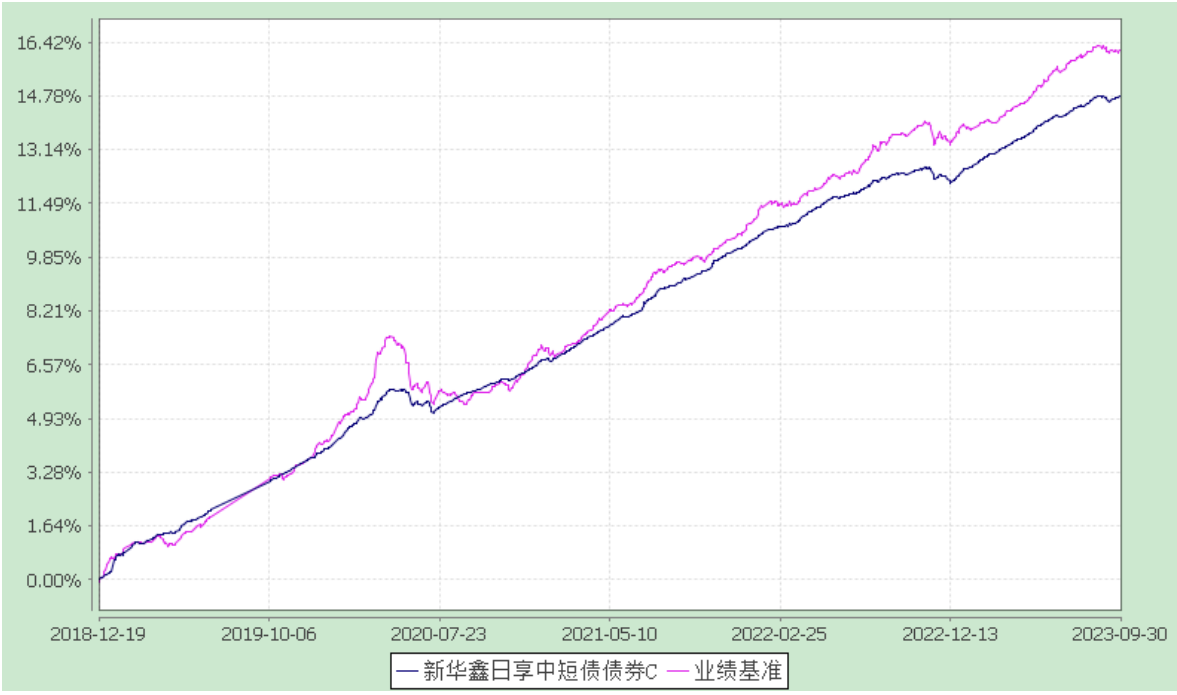
累计净值增长率与业绩比较基准收益率的历史走势对比图

(2018 年 12 月 19 日至 2023 年 9 月 30 日)

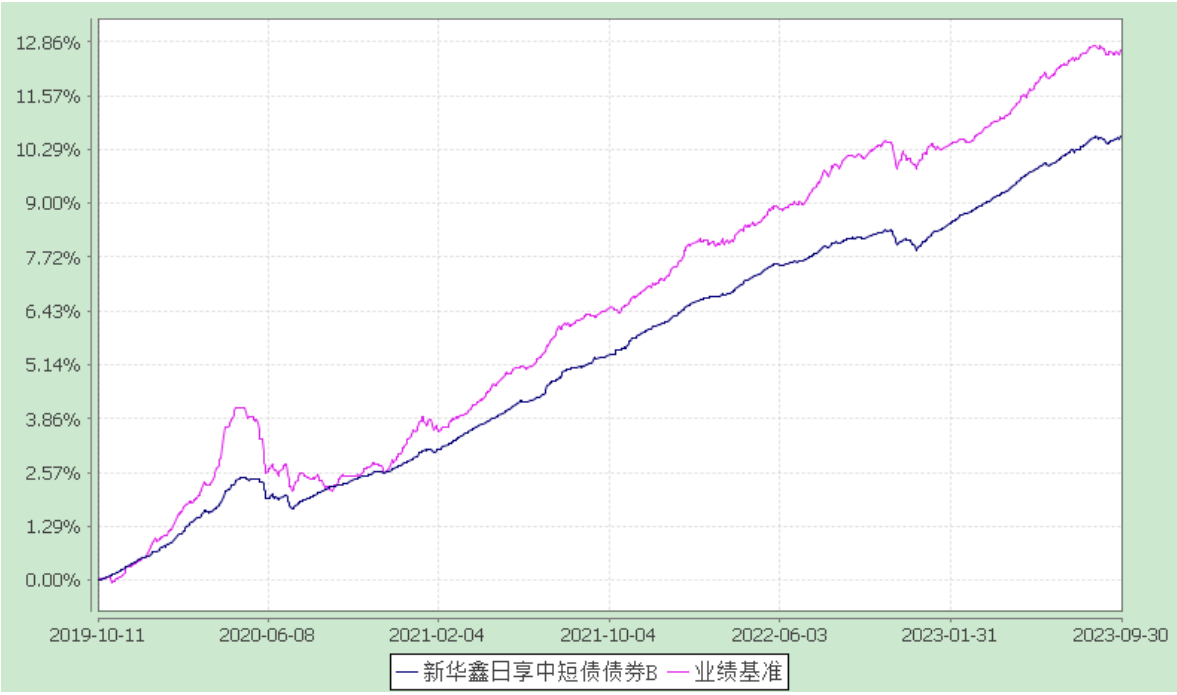
1．新华鑫日享中短债债券 A：



2．新华鑫日享中短债债券 C：



3．新华鑫日享中短债债券 B：



注：1、报告期内本基金各项资产配置比例符合本基金合同的有关约定；

2、本基金于 2019 年 10 月 11 日起新增 B 类基金份额。

§4 管理人报告

4.1基金经理（或基金经理小组）简介

姓名	职务	任本基金的基金经理期限		证券从业年限	说明
		任职日期	离任日期		
郑毅	本基金基金经理，总经理助理兼固定收益投资部总监，新华利率债债券型证券投资基金基金经理、新华增盈回报债券型证券投资基金基金经理、新华红利回报混合型证券投资基金基金经理、新华安康多元收益一年持有期混合型证券投资基金基金经理、新华安享惠金定期开放债券型证券投资基金基金经理、新华丰利债券型证券投资基金基金经理。	2021-11-26	2023-07-19	12	学士。历任天风证券股份有限公司固定收益总部交易员、固收投资部副总经理、资管分公司策略投资一部总经理、资管分公司总经理助理。
赵楠	本基金基金经理，新华利率债债券型证券投资基金基金经理、新华中债1-5 年农发行债券指数证券投资基金基金经理、新华纯债添利债券型发起式证券投资基	2018-12-19	-	11	经济学博士，历任新华基金管理股份有限公司宏观研究、策略研究、信用评级、基金经理助理。

	金基金经理。				

注：1、上述任职日期、离任日期根据本基金管理人对外披露的任免日期填写。

2、证券从业的含义遵从行业协会《证券业从业人员资格管理办法》、《基金从业人员管理规则》的相关规定。

4.1.1 期末兼任私募资产管理计划投资经理的基金经理同时管理的产品情况

本报告期末本基金基金经理未兼任私募资产管理计划投资经理。

4.2报告期内本基金运作遵规守信情况说明

本报告期，新华基金管理股份有限公司作为新华鑫日享中短债债券型证券投资基金的管理人按照《中华人民共和国证券投资基金法》、《新华鑫日享中短债债券型证券投资基金基金合同》以及其它有关法律法规的规定，本着诚实信用、勤勉尽责的原则管理和运用基金资产，在严格控制风险的基础上为持有人谋求最大利益。运作整体合法合规，无损害基金持有人利益的行为。

4.3公平交易专项说明

4.3.1 公平交易制度的执行情况

根据中国证监会颁布的《证券投资基金管理公司公平交易制度指导意见》（2011 年修订），公司制定了《新华基金管理股份有限公司公平交易管理办法》，以避免出现不正当关联交易、利益输送等违法违规行为。该办法规范的范围包括境内上市股票、债券的一级市场申购、二级市场交易等所有投资管理活动，同时包括授权、研究分析、投资决策、交易执行等投资管理活动相关的各个环节。

公司通过合理设置各类资产管理业务之间以及各类资产管理业务内部的组织结构，在保证各投资组合投资决策相对独立性的同时，使各投资组合在获得投资信息、投资建议和实施投资决策方面享有公平的机会，并重视交易执行环节的公平交易措施，以“价格优先、时间优先、综合平衡、比例实施”作为交易执行的公平原则，保证交易在各投资组合间的公正实施，保证各投资组合间的利益公平对待。

本报告期内，公平交易管理执行情况良好。

4.3.2 异常交易行为的专项说明

本报告期，公司对不同组合不同时间段的同向交易价差进行了溢价率样本的采集，通过平均溢价率、买入/卖出溢价率以及利益输送金额等多个层面来判断不同投资组合之间在某一时间段是否存在违反公平交易原则的异常情况，未发现重大异常情况，且不存在报告期内所有投资组合参与的交易所公开竞价同日反向交易成交较少的单边成交量超过该证券当日成交量的 5%的情况。

4.4报告期内基金的投资策略和运作分析

三季度，海外地缘政治冲突依旧，通胀高位运行，美联储加息节奏趋缓，国内宏观经济相对二季度有所回升，总体仍然偏弱。数据上看，国内消费和出口数据有所修复，房地产和基建数据放缓，制造业 PMI 缓慢修复并于 9 月重回扩张区间，CPI 转正但仍在低位，实体融资需求偏弱，汇率压力上升。在此背景下，今年整体政策取向稳健，以稳增长、稳物价、稳就业为主，恢复和扩大消费为优先，货币政策维持稳定性和持续性，总量和结构性政策兼有，强调跨周期调节，随着经济形势变化适度调整，8 月 MLF 和 1 年 LPR 利率继续下调。三季度政治局会议的召开和再融资债政策的推出对市场风险偏好有所提振，同时经济基本面的曲折复苏也反应在长端利率走势上，债券市场走势来看，三季度利率债震荡上行，10 年期国债上行 4bp 至 2.68%；资金中枢较二季度显著上行，带动 1 年期国债上行 30bp 至 2.17%，曲线走平。信用债方面，由于静态收益率明显下降、机构行为等因素，三季度总体先下后上，8 月下旬受资金影响短久期上行显著高于中长久期，但总体信用稳于利率。

本报告期内，主要采用票息和杠杆策略，阶段性调整久期和杠杆，债券投向以高资质高评级产业为主，短久期城投为辅，同时阶段性增配偏利率品种，以提供稳定回报为主要目标。

4.5报告期内基金的业绩表现

截至2023年9月30日，本基金A类份额净值为1.0485元，本报告期份额净值增长率为0.57%，同期比较基准的增长率为 0.41%；本基金 C 类份额净值为 1.0431 元，本报告期份额净值增长率为 0.49%，同期比较基准的增长率为 0.41%，B 类份额净值为 1.0368 元，本报告期份额净值增长率为 0.55%，同期比较基准的增长率为 0.41%。

4.6报告期内基金持有人数或基金资产净值预警说明

本报告期本基金未出现连续二十个工作日基金份额持有人数量不满二百人或者基金资产净值低于五千万的情形。

§5 投资组合报告

5.1报告期末基金资产组合情况

序号	项目	金额(元)	占基金总资产的比例(%)
1	权益投资	-	-

	其中：股票	-	-
2	固定收益投资	1,206,121,878.47	98.79
	其中：债券	1,206,121,878.47	98.79
	资产支持证券	-	-
3	贵金属投资	-	-
4	金融衍生品投资	-	-
5	买入返售金融资产	-	-
	其中：买断式回购的买入返售金融资产	-	-
6	银行存款和结算备付金合计	9,829,958.18	0.81
7	其他各项资产	4,896,135.44	0.40
8	合计	1,220,847,972.09	100.00

5.2报告期末按行业分类的股票投资组合

5.2.1 报告期末按行业分类的境内股票投资组合

本基金本报告期末未持有股票。

5.2.2 报告期末按行业分类的港股通投资股票投资组合

本基金本报告期末未持有港股通股票。

5.3 报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名股票投资明细

本基金本报告期末未持有股票。

5.4报告期末按债券品种分类的债券投资组合

序号	债券品种	公允价值(元)	占基金资产净值比例(%)
1	国家债券	20,235,497.27	2.01
2	央行票据	-	-
3	金融债券	222,669,433.84	22.12
	其中：政策性金融债	212,478,626.17	21.10
4	企业债券	20,835,923.88	2.07

5	企业短期融资券	487,351,276.10	48.41
6	中期票据	455,029,747.38	45.20
7	可转债（可交换债）	-	-
8	同业存单	-	-
9	其他	-	-
10	合计	1,206,121,878.47	119.80

5.5报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名债券投资明细

序号	债券代码	债券名称	数量（张）	公允价值(元)	占基金资产净值比例（%）
1	092218005	22 农发清发 05	600,000	61,152,180.82	6.07
2	210207	21 国开 07	400,000	40,559,540.98	4.03
3	012381609	23 越秀交通 SCP002	400,000	40,414,395.63	4.01
4	210406	21 农发 06	400,000	40,366,754.10	4.01
5	092218003	22 农发清发 03	400,000	40,287,016.39	4.00

5.6报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前十名资产支持证券投资明细

本基金本报告期末未持有资产支持证券。

5.7报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名贵金属投资明细

本基金本报告期末未持有贵金属。

5.8报告期末按公允价值占基金资产净值比例大小排序的前五名权证投资明细

本基金本报告期末未持有权证。

5.9 报告期末本基金投资的股指期货交易情况说明

5.9.1 报告期末本基金投资的股指期货持仓和损益明细

本基金本报告期末未持有股指期货。

5.9.2 本基金投资股指期货的投资政策

根据本基金基金合同，本基金不能投资于股指期货。

5.10 报告期末本基金投资的国债期货交易情况说明

5.10.1 本期国债期货投资政策

根据本基金基金合同，本基金不能投资于国债期货。

5.10.2报告期末本基金投资的国债期货持仓和损益明细

本基金本报告期末未持有国债期货。

5.10.3 本期国债期货投资评价

本基金本报告期末未持有国债期货。

5.11投资组合报告附注

5.11.1 本基金投资的前十名证券的发行主体本期是否出现被监管部门立案调查，或在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情形

本报告期内本基金投资的前十名证券的发行主体没有被监管部门立案调查，或在报告编制日前一年内受到公开谴责、处罚的情形。

5.11.2 基金投资的前十名股票是否超出基金合同规定的备选股票库

本基金本报告期末未持有股票。

5.11.3其他各项资产构成

序号	名称	金额(元)
1	存出保证金	270.30
2	应收证券清算款	-
3	应收股利	-
4	应收利息	-
5	应收申购款	4,895,865.14
6	其他应收款	-
7	待摊费用	-
8	其他	-
9	合计	4,896,135.44

5.11.4报告期末持有的处于转股期的可转换债券明细

本基金本报告期末未持有处于转股期的可转换债券。

5.11.5报告期末前十名股票中存在流通受限情况的说明

本基金本报告期末未持有股票。

5.11.6 投资组合报告附注的其他文字描述部分

由于四舍五入的原因，分项之和与合计之间可能存在尾差。

§6 开放式基金份额变动

单位：份

项目	新华鑫日享中短债债券A	新华鑫日享中短债债券C	新华鑫日享中短债债券B
本报告期期初基金份额总额	912,198,584.98	130,836,404.07	208,589,922.60
报告期期间基金总申购份额	112,290,286.13	20,044,006.29	90,648,981.87
减：报告期期间基金总赎回份额	366,844,177.80	47,955,682.65	96,795,199.48
报告期期间基金拆分变动份额	-	-	-
本报告期期末基金份额总额	657,644,693.31	102,924,727.71	202,443,704.99

§7 基金管理人运用固有资金投资本基金情况

7.1 基金管理人持有本基金份额变动情况

报告期内，基金管理人未运用固有资金申购、赎回或者买卖本基金的基金份额。

7.2 基金管理人运用固有资金投资本基金交易明细

报告期内，基金管理人未运用固有资金申购、赎回或者买卖本基金的基金份额。

§8 影响投资者决策的其他重要信息

8.1 报告期内单一投资者持有基金份额比例达到或超过20%的情况

投资者类别	报告期内持有基金份额变化情况					报告期末持有基金情况	
	序号	持有基金份额比例达到或者超过20%的时间区间	期初份额	申购份额	赎回份额	持有份额	份额占比
机构	1	20230701-20230930	387,633,491.62	-	-	387,633,491.62	40.25%
产品特有风险							
1、本基金为纯债债券型基金，债券的投资比例不低于基金资产的 80%，且主要投资于中短债主题证券，中短债主题证券是指剩余期限不超过三年的债券资产，该类债券的特定风险即成为本基金及投资者主要面对的特定投资风险。债券的投资收益会受到宏观经济、政府产业政策、货币政策、市场需求变化、行业波动等因素的影响，可能存在所选投资标的的成长性与市场一致预期不符而造成个券价格表现低于预期的风险。 2、本基金投资于中小企业私募债券所面临的信用风险及流动性风险。信用风险主要是由目前国内中小企业的发展状况所导致的发行人违约、不按时偿付本金或利息的风险；流动性风险主要是由债券非公开发行和转让所导致的无法按照合理的价格及时变现的风险。由于中小企业私募债券的特殊性，本基金的总体风险将有所提高。 3、本基金投资资产支持证券，资产支持证券是一种债券性质的金融工具。资产支持证券具有一定的价格波动风险、流动性风险、信用风险等风险。基金管理人将本着谨慎和控制风险的原则进行资产支持证券的投资，请基金份额持有人关注包括投资资产支持证券可能导致的基金净值波动、流动性风险和信用风险在内的各项风险。 4、基金合同提前终止的风险：如出现《基金合同》第五部分第三条约定的资产规模过小、基金份额持有人人数较少等情形的，《基金合同》将终止。							

8.2 影响投资者决策的其他重要信息

本报告期内本基金未有影响投资者决策的其他重要信息。

§9 备查文件目录

9.1备查文件目录

(一)中国证监会批准新华鑫日享中短债债券型证券投资基金募集的文件

(二)关于申请募集新华鑫日享中短债债券型证券投资基金之法律意见书

(三)《新华鑫日享中短债债券型证券投资基金基金合同》

(四)《新华鑫日享中短债债券型证券投资基金托管协议》

(五)《新华基金管理股份有限公司开放式基金业务规则》

(六)更新的《新华鑫日享中短债债券型证券投资基金招募说明书》

（七）《新华鑫日享中短债债券型证券投资基金产品资料概要》（更新）

(八)基金管理人业务资格批件、营业执照和公司章程

(九)基金托管人业务资格批件及营业执照

9.2存放地点

基金管理人、基金托管人住所。

9.3查阅方式

资者可在营业时间内免费查阅，也可按工本费购买复印件，或通过本基金管理人网站查阅。

新华基金管理股份有限公司

二〇二三年十月二十五日